建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金 2017年年度报告摘要

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
送出日期:2018年3月28日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年3月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2017年1月1日起至12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	建信丰裕
场内简称	建信丰裕
基金主代码	165317
基金运作方式	契约型 本基金自《基金合同》生效之日起(含)至基金合同生效日24个月(含)后对应日(如遇非工作日,或该年份日历中不存在该对应日的,则顺延至下一个工作日)止的期间为封闭期。 封闭期届满后,本基金开放运作。
基金合同生效日	2016年9月29日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	640,857,885.49份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2017年10月13日

2.2 基金产品说明

投资目标	在封闭期内,本基金主要投资于定向增发的证券,基金管理人在严格控制风险的前提下,通过对定向增发证券投资价值的深入分析,力争基金资产的长期稳定增值。开放运作后,本基金主要在对公司股票投资价值的长期跟踪和深入分析的基础上,挖掘和把握国内经济结构调整和升级的大背景下的事件性投资机会,力争基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将按照风险收益配比原则,实行动态的资产配置。在本基金的封闭期,基金管理人将主要采取参与定向增发策略,本基金开放式运作后,主要采用事件驱动的投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中债综合指数收益率(全价)×50%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中高收益/风险特征的基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴剛明	王永民
	联系电话	010-66228888	010-66594896
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-81-96533 010-66228000	95566
传真		010-66228001	010-66594942

2.4信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017年	2016年9月29日(基金合同生效日)-2016年12月31日	2015年
本期已实现收益	34,778,538.88	-3,336,716.25	-
本期利润	22,984,835.77	-13,920,294.23	-
加权平均基金份额本期利润	0.0359	-0.0217	-
本期基金份额净值增长率	3.66%	-2.17%	-
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	0.0141	-0.0217	-
期末基金资产净值	649,922,427.03	626,937,591.26	-
期末基金份额净值	1.0141	0.9783	-

1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润的计算方法:如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分;如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分)。

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

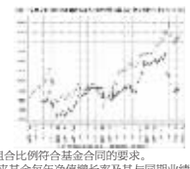
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.67%	0.44%	1.96%	0.40%	-5.63%	0.04%
过去六个月	0.25%	0.40%	4.25%	0.35%	-4.00%	0.05%
过去一年	3.66%	0.35%	8.60%	0.32%	-4.94%	0.03%
自基金合同生效起至今	1.41%	0.34%	8.70%	0.33%	-7.29%	0.01%

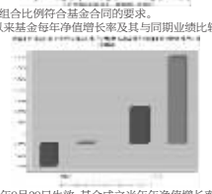
本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×50%+中债综合指数收益率(全价)×50%。沪深300指数选样科学客观,流动性高,是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。中债综合指数具广泛市场代表性,旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。基于本基金的特征,使用上述业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



本报告期末基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



本基金基金合同于2016年9月29日生效,基金成立当年年净值增长率以实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
自基金合同生效以来,本基金未实施利润分配。					

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准,建信基金管理有限责任公司成立于2005年9月19日,注册资本2亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司,其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的65%,信安金融服务公司出资额占注册资本的25%,中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本的10%。

公司下设综合管理部、权益投资部、固定收益投资部、金融工程及指数投资部、专户投资部、海外投资部、资产配置及量化投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、机构业务部、网络金融部、人力资源管理部、基金运营部、财务管理部、信息技术部、风险管理部和内控合规部,以及深圳、成都、上海、北京、广州五家分公司和华东、西北、东北、武汉、南京五个营销中心,并在上海设立了子公司--建信资本管理有限责任公司。自成立以来,公司秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观,恪守“持有人利益重于泰山”的原则,以“建设财富生活”为崇高使命,坚持规范运作,致力成为“国际一流、国内领先的综合性资产管理公司”。

截至2017年12月31日,公司旗下有建信恒久价值混合型证券投资基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信优势动力混合型证券投资基金(LOF)、建信创新中国混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信沪深300指数证券投资基金(LOF)、建信深证100指数增强型证券投资基金、建信中证500指数增强型证券投资基金、建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金、建信全球机遇混合型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金、建信全球资源混合型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金、建信安心保本二号混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信环保产业股票型证券投资基金、建信回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金、建信互联网+产业升级股票型证券投资基金、建信大安全战略精选股票型证券投资基金、建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金、建信精工制造指数增强型证券投资基金、建信安心保本二号混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信安心保本三号混合型证券投资基金、建信安心保本五号混合型证券投资基金、建信目标收益一年期债券型证券投资基金、建信现代服务业股票型证券投资基金、建信安心保本六号混合型证券投资基金、建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金、建信安心保本七号混合型证券投资基金、建信目标收益一年期债券型证券投资基金、建信现代服务业股票型证券投资基金、建信安心保本八号混合型证券投资基金、建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金、建信睿丰回报定期开放混合型证券投资基金、建信瑞福添利混合型证券投资基金、建信高端医疗股票型证券投资基金、建信中证政策性金融债1-3年指数证券投资基金(LOF)基金、建信中证政策性金融债3-5年指数证券投资基金(LOF)基金、建信中证政策性金融债8-10年指数证券投资基金(LOF)基金、建信中证政策性金融债5-8年指数证券投资基金(LOF)基金、建信睿源纯债债券型证券投资基金、建信建信量化事件驱动股票型证券投资基金、建信福泽安泰混合型基金中基金(FOF)、建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金、建信上证50交易型开放式指数证券投资基金,共计95只开放式基金,管理的基金净资产规模共计为3,609.83亿元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴尚伟	权益投资部联席投资官、本基金的基金经理	2016年9月29日	-	11	硕士,权益投资部联席投资官。2004年9月至2007年4月任长城传业期货经纪有限公司深圳分公司投资顾问;2008年3月至2011年7月任银华基金管理公司研究员;2011年7月加入我公司,历任研究员、研究主管、研究部总监助理、权益投资部基金经理兼研究部总经理助理、权益投资部联席投资官,2014年11月25日起任建信内生动力混合型证券投资基金的基金经理;2016年9月29日起任建信丰裕定期灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2017年1月24日起任建信稳价值混合型证券投资基金的基金经理;2018年1月30日起任建信安心保本五号混合型证券投资基金的基金经理。该基金于2018年2月6日起转型为建信弘利灵活配置混合型证券投资基金,吴尚伟继续担任该基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,没有发生违反法律法规的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了公平对待投资人,保护投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等法律法规和公司内部制度,制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块,一旦出现不同基金同时买卖同一证券时,系统自动切换至公平交易模块进行操作,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内,本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》的规定。

本基金管理人对过去四个季度不同时间窗口下(日内、3日内、5日内)管理的不同投资组合(包括封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合等)同向交易的交易价差从T检验(置信度为95%)、平均溢价率、贡献率、正溢价率占优频率等几个方面进行了专项分析。具体分析结果如下:

当时间窗为1日时,配了31458对投资组合,有6807对投资组合未通过T检验,其中3392对投资组合的正溢价率占优频率小于55%,其它3415对正溢价率占优频率大于55%的投资组合中,2509对平均溢价率低于2%,其它906对平均溢价率超过2%的投资组合中,有20对投资组合的贡献率超过5%,但因为其溢价金额占平均净值的比例较低,因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为;

当时间窗为3日时,配了34512对投资组合,有8794对投资组合未通过T检验,其中3914对投资组合的溢价率占优频率均小于55%,其它4880对正溢价率占优频率大于55%的投资组合中,4523对平均溢价率低于5%,其它357对平均溢价率超过5%的投资组合,有5对投资组合贡献率超过5%,但因为其溢价金额占平均净值的比例较低,因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为;

当时间窗为5日时,配了35964对投资组合,有10419对投资组合未通过T检验,其中4515对投资组合的溢价率占优频率均小于55%,其它5904对正溢价率占优频率大于55%的投资组合中,5809对平均溢价率低于10%,其它96对平均溢价率超过10%的投资组合,有3对投资组合贡献率超过5%,但因为其溢价金额占平均净值的比例较低,因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有3次,原因是投资组合投资策略需要,未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2017年宏观经济情况,在国内金融去杠杆、“供给侧”改革叠加全球经济复苏的大环境下:1)流动性层面。金融去杠杆持续加码,表外收缩与债券利率走高,融资需求转向信贷,银行不良下降同时息差上行、资产负债表得到修复;2)全球经济复苏。外需回升、带动制造业投资回升;3)行业层面。“供给侧”改革与环保限产加速传统行业产能出清、集中度提升、龙头盈利大幅改善;4)投资者机构化,增量海外资金占据一定话语权。A股市场全年表现出低波动率的结构性牛市:低估值、大市值的蓝筹股走牛,而高估值、业绩差的小票持续下跌。

回顾来看,年初周期板块与金融股显著跑赢,核心原因是1-2月信贷数据延续了2016年底以来的强势改善,叠加欧美复苏带动出口数据超预期,市场对经济复苏预期显著加强,风险偏好提升。其后,伴随一行三会不断出台文件加强金融监管,风险偏好回落,市场在4-5月出现了快速调整。此时白酒和家电在自身需求与价格景气周期的作用下,开始走出独立行情。经历快速调整的市场在三季度企稳反弹,成长和周期表现较好,尤其是“供给侧”改革驱动周期股行情贯穿了整个三季度。国庆节后,消费与金融龙头股开始单边快速上涨。一个重要原因是,外资在资金增量上占据话语权。外资持有A股的市值占比从16年12月的1.65%提升到17年12月的2.61%,“漂亮50”行情演绎极致。整体来看,消费白马和权重蓝筹板块保持了全年最优的收益风险比,防御性和进攻性均具备。

本基金在17年采取了彰极参与定增及打新股的策略,考虑到基金规模、合理估值、精选个股的维度,累计参与了8家公司定增项目。同时,我们选取了低估值蓝筹股票作为底仓,积极参与了打新股工作并享受了底仓股票的增值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率3.66%,波动率0.35%,业绩比较基准收益率8.6%,波动率0.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2018年,宏观经济方面,预计增速有小幅回落,但增长的质量会持续提高。从三大需求拉动上看,消费仍是拉动经济增长的主要动力:外需贡献会有小幅下行,但整体中枢位置仍然相对稳定,对经济仍有正面贡献;投资端由于制造业资本支出持续回升可能迎来企稳改善,对整体投资数据有正向拉动。

我们可能面临的不利因素主要来自两方面,一是地产投资可能出现趋势向下,包括从销售到投资的传导趋弱、地产链条的资金压力累积、棚改安置的力度边际减弱等;二是基建投资的资金来源受金融去杠杆影响出现被动收缩,地方政府投资意愿和投资能力均下降。同时,我们认为需要重点关注通胀压力和流动性阶段性紧张的压力。预计全年CPI中枢维持在2.5%附近,PPI底部可能出现在3%附近,整体广谱价格中枢抬升,通胀压力温和上行。2018年油价将是通胀最直接的压力来源,且间接传导的影响较大。

2018年货币政策将面临更加复杂的决策环境。预计利率水平贯穿全年都可能是高位震荡态势,且有上行压力。在流动性方面,我们将密切关注潜在的信用风险的影响。

考虑到积极为投资者创造回报,基于17年监管机构出台的减持新规的影响,我们将适时申请修改基金合同,适度调整合同中各类资产的投资比例要求,增加二级市场股票的投资权重。我们预计2018年股票市场相比2016-2017年波动加大,我们将在“结构选择”和“仓位管理”上更加审慎,并力求通过灵活的结构调整把握阶段性机会。本基金仍会继续维持消费品和权重蓝筹的底仓配置,尤其在海外资金仍可能继续流入A股的全球大类资产配置趋势中。我们同时关注风格轮动的时间窗口,尤其是经济预期开始稳定且流动性边际缓和的时点,将适当关注优质成长股的投资机会,包括科技硬件、新能源产业、高端制造、军工装备等。

我们将在新的一年,勤勉尽责,尽力为基金持有人创造回报。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内,本管理人根据中国证监会[2017]13号文《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定,继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

本公司设立资产估值委员会,主要负责审核和决定受托资产估值相关事宜,确保受托资产估值流程和结果公允合理。资产估值委员会由公司分管核算业务的高管、督察长、内控合规部、风险管理部和资产核算部门负责人组成。分管投资、研究业务的公司高管、相关投资管理部门负责人、相关研究部门负责人作为投资产品价值研究的专业成员出席资产估值委员会会议。

资产估值委员会成员均为多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理工作,熟悉业内法律法规的专家型人员。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法,但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

本公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》,与中债金融估值中心有限公司签署《中债信息产品服务协议》,并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值(适用非货币基金)或影子定价(适用货币基金和理财类基金);对公司旗下基金持有的在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),本公司采用中证指数有限公司独立提供的债券估值价格进行估值。

本公司与中证指数有限公司签署《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》,并依据《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》和中证指数有限公司独立提供的流通受限股票流动性折扣,对公司旗下基金持有的流通受限股票进行估值。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未实施利润分配,符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在建信丰裕定增灵活配置混合型证券投资基金的(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金资产和持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务报告、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计了建信丰裕定增灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“建信丰裕基金”)的财务报表,包括2017年12月31日的资产负债表,2017年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注,并出具了普华永道中天审字(2018)第22649号标准无保留意见。投资者可通过年度报告正文查看审计报告正文。

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:建信丰裕定增灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2017年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资 产:			
银行存款		353,108,211.02	197,003,588.28
结算备付金		48,494.91	4,591,080.33
存出保证金		44,443.75	165,477.78
交易性金融资产		298,117,282.66	178,344,679.90
其中:股票投资		298,117,282.66	176,159,168.10
基金投资		-	-
债券投资		-	2,185,511.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	250,000,000.00
应收证券清算款		-	48,308,246.35
应收利息		70,401.17	72,932.10
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		651,388,833.51	678,486,004.74
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	49,966,166.66
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		828,526.74	805,263.36
应付托管费		138,087.78	134,210.57
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		83,425.84	501,723.71
应交税费		-	-
应付利息		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		416,366.12	141,049.18
负债合计		1,466,406.48	51,548,413.48
所有者权益:			
实收基金		640,857,885.49	640,857,885.49
未分配利润		9,064,541.54	-13,920,294.23
所有者权益合计		649,922,427.03	626,937,591.26
负债和所有者权益总计		651,388,833.51	678,486,004.74

报告截止日2017年12月31日,基金份额净值1.0141元,基金份额总额640,857,885.49份。

7.2 利润表

会计主体:建信丰裕定增灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2017年1月1日至2017年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年9月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日
一、收入		35,724,981.45	-10,183,509.04
1.利息收入		4,243,553.29	1,773,683.17
其中:存款利息收入		1,994,963.00	841,411.29
债券利息收入		2,335.10	2,701.39
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,246,255.19	929,569.89
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		43,275,131.27	-1,373,634.98
其中:股票投资收益		40,155,687.78	-1,373,634.98
基金投资收益		-	-
债券投资收益		30,050.11	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		3,089,393.38	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-11,793,703.11	-10,583,577.98
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		-	20.75
减:二、费用		12,740,145.68	3,736,785.19
1. 管理人报酬		9,793,968.02	2,434,337.89
2. 托管费		1,632,328.00	405,723.00
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		896,998.12	749,421.86
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		417,851.54	147,302.44
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		22,984,835.77	-13,920,294.23
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		22,984,835.77	-13,920,294.23

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:建信丰裕定增灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2017年1月1日至2017年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	640,857,885.49	-13,920,294.23	626,937,591.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	22,984,835.77	22,984,835.77
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	640,857,885.49	9,064,541.54	649,922,427.03

项目	上年度可比期间 2016年9月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	640,857,885.49	-	640,857,885.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-13,920,294.23	-13,920,294.23
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	640,857,885.49	-13,920,294.23	626,937,591.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

孙志嵘 吴剛明 丁颖

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

建信丰裕定增灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1669号《关于准予建信丰裕定增灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信丰裕定增灵活配置混合型证券投资基金合同》负责公开募集。本基金为契约型封闭式,封闭期限为2年。封闭期届满后,本基金转成为上市开放式基金(LOF),存续期不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币640,414,181.26元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1125号予以验证。经向中国证监会备案,《建信丰裕定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年9月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为640,857,885.49份基金份额,其中认购资金利息折合443,704.23份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2017]635号核准,本基金1,653,241.00份基金份额于2017年10月13日在深交所挂牌交易。上市的基金份额登记在证券登记结算系统,可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回;未上市的基金份额登记在注册登记系统,按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信丰裕定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票(含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票等)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、次级债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。在封闭期,本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的0%-100%,其中定向增发(非公开发行)股票资产占非现金基金资产的比例不低于80%;开放运作后,本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的0%-95%,其中以事件驱动策略投资的股票资产占非现金基金资产的比例不低于80%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。权证投资比例不得超过基金资产净值的3%。本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×50%+中债综合指数收益率(全价)×50%。

本财务报表由本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司于2018年3月21日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信丰裕定增灵活配置混合型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2017年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。比较财务报表的实际编制期间为2016年9月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的款中包含的债券利息或产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付